# 恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）摘要

2019年第2号

基金管理人：华夏基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2012年6月14日证监许可[2012]822号文核准募集。本基金基金合同于2012年8月21日正式生效。根据基金管理人2018年9月14日刊登的《华夏基金管理有限公司关于修订华夏恒生ETF联接、华夏中证500ETF联接、华夏上证50AH优选指数（LOF）基金合同的公告》及《华夏基金管理有限公司关于华夏恒生ETF联接、华夏中证500ETF联接、华夏上证50AH优选指数（LOF）增加C类基金份额的公告》，本基金自2018年9月19日起增加C类基金份额类别。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为恒生ETF的联接基金，基金净值会因为恒生ETF净值波动等因素产生波动，恒生ETF主要跟踪香港市场的恒生指数，其投资的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：香港市场政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险；汇率风险；由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险；本基金的特定风险等。本基金为恒生ETF的联接基金，主要通过投资恒生ETF紧密跟踪标的指数的表现，与恒生ETF在投资方法、交易方式等方面存在着联系和区别。恒生ETF为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

本基金的目标ETF主要投资于香港市场以港币计价的金融工具，本基金除投资目标ETF外，也可能投资于香港市场，港币相对于人民币的汇率变化可能会影响本基金的资产净值，从而对基金业绩产生影响。本基金同时以人民币和美元销售，美元申购赎回价格为按照基金份额净值除以中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价计算的美元折算净值，由于存在汇率波动，可能导致以美元计算的收益率和以人民币计算的收益率有所差异。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2019年8月21日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年6月30日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

## 一、基金的名称

本基金名称：恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

## 二、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

## 三、基金的投资目标

本基金主要通过对恒生ETF基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。

## 四、基金的投资方向

本基金主要投资于目标ETF基金份额及跟踪标的指数的股票组合。基金在境内可投资于货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具。此外，基金还可投资于境外证券市场的股票、债券、基金、金融衍生工具（包括但不限于远期合约、互换、期货、期权、权证等）以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 五、基金的投资策略

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合恒生ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。基金还将适度参与恒生ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。基金也可以通过买入恒生指数成份股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还可投资于境外证券市场的股票、债券、跟踪同一标的指数的其他基金、金融衍生工具等产品，并在法规允许的条件下参与证券借贷，以增加收益。

在目标ETF开放申购赎回之前，本基金可通过特殊申购的方式用基金资产换购目标ETF份额，以进行基金建仓。

为了更好地对外币资金进行投资管理，本基金还可以与目标ETF或其他QDII基金进行外汇互换，互换价格需遵循公允、合理的原则以及监管机构的相关规定。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

基金管理人可根据市场情况调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

## 六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的标的指数收益率×95%＋人民币活期存款税后利率×5%。其中，经人民币汇率调整的标的指数为人民币/港币汇率×恒生指数，人民币活期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构人民币活期存款基准利率。

本基金标的指数变更的，业绩比较基准将随之变更。基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，不需另行召开持有人大会。

## 七、风险收益特征

本基金为恒生ETF的联接基金，恒生ETF为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

## 八、基金投资组合报告

以下内容摘自本基金2019年第2季度报告：

“5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | – | – |
| | 其中：普通股 | – | – |
| | 存托凭证 | – | – |
| | 优先股 | – | – |
| | 房地产信托 | – | – |
| 2 | 基金投资 | 1,092,422,019.30 | 92.16 |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 金融衍生品投资 | – | – |
| | 其中：远期 | – | – |
| | 期货 | – | – |
| | 期权 | – | – |
| | 权证 | – | – |
| 5 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 6 | 货币市场工具 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 89,691,689.72 | 7.57 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,245,918.17 | 0.27 |
| 9 | 合计 | 1,185,359,627.19 | 100.00 |

5.2报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 股指期货 | HANG SENG IDX FUT Jul19 | – | – |
| 2 | – | – | – | – |
| 3 | – | – | – | – |
| 4 | – | – | – | – |
| 5 | – | – | – | – |

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖）（单位：手） | 合约市值 | 公允价值变动 |
|---|---|---|---|---|
| HIN9 | HANG SENG IDX FUT Jul19 | 23 | 28,743,594.14 | 139,602.04 |
| 公允价值变动总额合计 | | | | 139,602.04 |
| 股指期货投资本期收益 | | | | 571,136.64 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 | | | | –400,805.66 |

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 华夏恒生ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 华夏基金管理有限公司 | 1,092,422,019.30 | 92.36 |
| 2 | – | – | – | – | – | – |
| 3 | – | – | – | – | – | – |
| 4 | – | – | – | – | – | – |
| 5 | – | – | – | – | – | – |
| 6 | – | – | – | – | – | – |
| 7 | – | – | – | – | – | – |
| 8 | – | – | – | – | – | – |
| 9 | – | – | – | – | – | – |
| 10 | – | – | – | – | – | – |

5.10投资组合报告附注

5.10.1报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,277,847.28 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 9,270.49 |
| 5 | 应收申购款 | 958,800.40 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 3,245,918.17 |

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。”

## 九、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

华夏恒生ETF联接A：

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2012年8月21日至2012年12月31日 | 3.00% | 0.17% | 11.07% | 0.86% | –8.07% | –0.69% |
| 2013年1月1日至2013年12月31日 | –0.10% | 0.91% | –0.17% | 0.95% | 0.07% | –0.04% |
| 2014年1月1日至2014年12月31日 | 3.89% | 0.85% | 1.60% | 0.85% | 2.29% | 0.00% |
| 2015年1月1日至2015年12月31日 | 1.03% | 1.31% | –1.21% | 1.32% | 2.24% | –0.01% |
| 2016年1月1日至2016年12月31日 | 10.54% | 1.08% | 6.92% | 1.12% | 3.62% | –0.04% |
| 2017年1月1日至2017年12月31日 | 28.64% | 0.72% | 25.63% | 0.72% | 3.01% | 0.00% |
| 2018年1月1日至2018年12月31日 | –8.93% | 1.23% | –8.90% | 1.22% | –0.03% | 0.01% |
| 2019年1月1日至2019年6月30日 | 11.47% | 0.94% | 10.34% | 0.94% | 1.13% | 0.00% |

华夏恒生ETF联接C：

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2018年9月19日至2018年12月31日 | –5.33% | 1.47% | –5.15% | 1.46% | –0.18% | 0.01% |
| 2019年1月1日至2019年6月30日 | 11.26% | 0.94% | 10.34% | 0.94% | 0.92% | 0.00% |

## 十、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司
住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
设立日期：1998年4月9日
法定代表人：杨明辉
联系人：邱曦
客户服务电话：400－818－6666
传真：010－63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元，公司股权结构如下：

| 持股单位 | 持股占总股本比例 |
|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 62.2% |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 13.9% |
| MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION | 13.9% |
| 天津海鹏科技咨询有限公司 | 10% |
| 合计 | 100% |

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

杨明辉先生：董事长、党委书记，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理、执行委员会委员，华夏基金（香港）有限公司董事长。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁，中信信托董事，信诚基金管理有限公司董事长，中国建银投资证券有限责任公司执行董事、总裁等。

Barry Sean McInerney先生：董事，硕士。现任万信投资公司（Mackenzie Financial Corporation）总裁兼首席执行官。曾在多家北美领先的金融机构担任高级管理职位。

胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席，兼任百胜中国控股有限公司非执行董事长，香港联交所与瑞银集团等上市公司董事等。曾任国际货币基金组织高级经济学家，达沃斯世界经济论坛首席经济学家，高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理等。

杨冰先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、资产管理业务行政负责人。曾任中信证券股份有限公司固定收益部交易员、资产管理业务投资经理、资产管理业务投资主管等。

李勇进先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、中信证券财富管理委员会主任。兼任中信期货有限公司董事、金通证券有限责任公司执行董事兼总经理。曾任中国农业银行大连市分行国际业务部科员，中银万国证券大连营业部部门经理，中信证券大连营业部总经理助理、副总经理、总经理，中信证券经纪业务管理部高级副总裁、总监，中信证券（浙江）有限责任公司总经理，中信证券浙江分公司总经理，中信证券经纪业务发展与管理委员会主任等。

李一梅女士：董事、总经理，硕士。兼任证通股份有限公司董事、华夏基金（香港）有限公司董事。曾任华夏基金管理有限公司副总经理、营销总监、市场总监、基金营销部总经理，上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理等。

张平先生：独立董事，博士。现任中国社科院经济研究所研究员。兼任民生通惠资产管理公司及香港中航工业国际独立董事。曾任中国社科院经济研究所宏观研究室副主任、经济增长室主任、所长助理、副所长，国家金融与发展实验室副主任等。

张宏久先生：独立董事，硕士。现任北京市竞天公诚律师事务所合伙人。兼任中信信托有限公司独立董事，全国律师协会金融专业委员会顾问，全国侨联法律顾问委员会委员及民事法律委员会主任，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员等。

支晓强先生：独立董事，博士。现任中国人民大学继续教育处处长、商学院财务与金融系教授、博士生导师。兼任全国会计专业学位研究生教育指导委员会委员兼副秘书长、中国会计学会财务成本分会副会长、财政部企业会计准则咨询委员会咨询专家、中国会计学会内部控制专业委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会委员、北农大科技股份有限公司独立董事等。

杨一夫先生：监事长，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司（Power Corporation of Canada）在中国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司（世界银行组织成员）驻中国的首席代表，华夏基金管理有限公司董事等。

杨维华先生：监事，硕士。现任中信证券股份有限公司风险管理部行政负责人、公司副首席风险官。曾任中信证券股份有限公司风险管理部B角（主持工作）、总监等。

史本良先生：监事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司计划财务部联席负责人、公司副财务总监。曾任中信证券股份有限公司计划财务部B角、总监等。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室总监、董事会秘书（兼）。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师等。

陈倩女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司市场部执行总经理、行政负责人。曾任中国投资银行业务经理，北京证券有限责任公司高级业务经理，华夏基金管理有限公司北京分公司副总经理、市场推广部副总经理等。

朱威先生：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司基金运作部执行总经理、行政负责人。曾任基金运作部B角等。

张霄岭先生：副总经理，博士。现兼任华夏基金（香港）有限公司首席执行官、中国石化销售股份有限公司董事、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利（纽约总部）信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监，华夏资本管理有限公司执行董事、总经理等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

李彬女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、合规部行政负责人。曾任职于中信证券股份有限公司、原中信基金管理有限责任公司。曾任华夏基金管理有限公司监察稽核部总经理助理，法律监察部副总经理、职席负责人等。

2、本基金基金经理

徐猛先生，清华大学工学硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006年2月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部基金经理助理、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2016年1月29日至2016年3月28日期间）等，现任数量投资部总监，上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年4月8日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年3月12日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年3月12日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年12月21日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年12月21日起任职）、中小企业板交易型开放式指数基金基金经理（2016年12月1日起任职）、华夏上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016年12月1日起任职）、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2017年12月8日起任职）、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年7月13日起任职）、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2018年8月14日起任职）、华夏中小企业板交易型开放式指数基金发起式联接基金基金经理（2018年9月10日起任职）、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019年6月5日起任职）。

历任基金经理：2012年8月21日至2017年2月10日期间，王路先生任基金经理；2012年8月21日至2017年11月10日期间，张弘弢先生任基金经理。

3、本公司量化投资决策委员会

主任：张弘弢先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。
成员：阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。
徐猛先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。
宋洋女士，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 十一、费用概览

（一）基金运作费用

1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

（1）基金管理人的管理费。
（2）基金托管人的托管费（含境外资产托管人收取的费用）。
（3）基金的销售服务费。
（4）标的指数使用许可费（包括为指数公司缴纳的相关税收以及与支付外币相关的汇兑损益、手续费、汇款费等）。
（5）基金投资目标ETF的相关费用（包括但不限于目标ETF的交易费用、申购赎回费用等）。
（6）因基金的证券交易或结算产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等）。
（7）基金合同生效以后的信息披露费用。
（8）基金份额持有人大会费用。
（9）基金合同生效以后的会计师费和律师费。
（10）基金进行外汇兑换交易的相关费用。
（11）基金的资金汇划费用。
（12）基金收益分配中发生的费用。
（13）与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等。
（14）其他为基金的利益而产生的费用，如代表基金投票产生的费用、与基金有关的诉讼费、追索费等。
（15）按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金投资目标ETF部分不收取管理费。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.60%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.60%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

本基金投资目标ETF部分不收取托管费。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类不收取销售服务费，C类销售服务费年费率为0.3%。

各类别基金份额的销售服务费计算方法如下：

H＝E×R÷当年天数

H为各类别基金份额每日应计提的销售服务费

E为各类别基金份额前一日基金资产净值

R为各类别基金份额适用的销售服务费率

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中划出，经登记结算机构分别支付给各个基金销售机构。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。

（4）标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与指数许可方签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。

根据指数使用许可协议，目前指数许可使用费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.04%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.04%÷当年天数

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。

标的指数许可使用费每日计算，按季支付。每年应支付的标的指数许可使用费不低于指数使用许可协议规定的下限。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

（5）基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（6）本条第（一）款第1项中第（5）至第（15）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，并列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

（二）基金销售费用

1、申购费与赎回费

（1）本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。对于A类基金份额，投资者在申购时需交纳前端申购费，各币种申购费率具体如下：

①人民币申购费率

| 申购金额（含申购费） | 前端申购费率 |
|---|---|
| 100万元以下 | 1.2% |
| 100万元以上（含100万元）–500万元以下 | 0.9% |
| 500万元以上（含500万元）–1000万元以下 | 0.6% |
| 1000万元以上（含1000万元） | 每笔1,000.00元 |

②美元申购费率

美元申购费率应参照人民币申购费率制定。本基金在开放申购之后的1年内对美元申购实行费率优惠，基金管理人决定自该费率优惠满1年之日起，对美元申购继续实行费率优惠，美元申购费率为0。如未来调整费率优惠水平或取消费率优惠，基金管理人将在招募说明书或相关公告中披露。

（2）本基金C类基金份额不收取申购费。

（3）本基金A类、C类基金份额均收取赎回费，赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。

A类基金份额赎回费率如下：

| 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|
| 7天以内 | 1.5% |
| 7天以上（含7天） | 0.5% |

C类份额的赎回费率如下：

赎回时份额持有不满7天的，收取1.5%的赎回费，持有满7天以上（含7天）的，赎回费为0。

对于赎回时份额持有不满7天的，收取的赎回费全额计入基金财产。对赎回时份额持有满7天以上（含7天）收取的赎回费，依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

（4）基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和调低赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施三日前在至少一种指定媒体上刊登公告。

（5）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，经代销机构同意后，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可根据法律法规要求对基金申购费率、赎回费率等进行适当费率优惠。

（6）当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

（1）T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T＋1日公告，计算公式为估值日基金资产净值除以估值日基金份额余额。基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。未来，若市场情况发生变化，或目标ETF净值计算和发布时间发生变化，或实际情况需要，经中国证监会允许，本基金可相应调整基金净值计算和公告时间或频率并提前公告。

（2）T日的美元折算净值由基金管理人计算，经基金托管人复核后在T+1日公告。T日的美元折算净值计算公式为T日基金份额净值除以中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价。美元折算净值保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。如遇特殊情况，基金管理人可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。基金也可根据实际情况调整美元折算净值计算和公告时间或频率并提前公告。

（3）申购份额的计算

①当投资者选择申购A类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

人民币申购份额的计算：

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额＝申购金额/（1＋人民币前端申购费率）

人民币前端申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/T日A类基金份额净值

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

人民币前端申购费用＝固定金额

净申购金额=申购金额－人民币前端申购费用

申购份额＝净申购金额/T日A类基金份额净值

美元申购份额的计算：

申购份额=申购金额/T日A类基金份额美元折算净值

其中，T日A类基金份额美元折算净值=T日A类基金份额净值/T日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后四位，由此产生的误差计入基金资产。

②当投资者选择申购C类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

申购份额＝申购金额/T日C类基金份额净值

③基金份额按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例一：假定T日的A类基金份额净值为1.2300元，三笔人民币申购金额分别为1,000.00元、100万元、500万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的A类基金份额计算如下：

| | 申购1 | 申购2 | 申购3 |
|---|---|---|---|
| 申购金额（元,a） | 1,000.00 | 1,000,000.00 | 5,000,000.00 |
| 适用前端申购费率（b） | 1.2% | 0.9% | 0.6% |
| 净申购金额（c=a/（1+b）） | 988.14 | 991,080.28 | 4,970,178.93 |
| 前端申购费（d=a–c） | 11.86 | 8,919.72 | 29,821.07 |
| T日该类基金份额净值（e） | 1.2300 | 1.2300 | 1.2300 |
| 申购份额（f=c/e） | 803.37 | 805,756.33 | 4,040,795.88 |

若人民币申购金额为1000万元，则申购负担的前端申购费用和获得的A类基金份额计算如下：

| | 申购4 |
|---|---|
| 申购金额（元,a） | 10,000,000.00 |
| 前端申购费（b） | 1,000.00 |
| 净申购金额（c=a–b） | 9,999,000.00 |
| T日基金份额净值（d） | 1.2300 |
| 申购份额（e=c/d） | 8,129,268.29 |

例二：假定T日A类基金份额美元折算净值为0.1951美元，四笔美元申购金额分别为5000.00美元、50万美元、100万美元、200万美元，则各笔申购获得的A类基金份额计算如下：

| | 申购1 | 申购2 | 申购3 | 申购4 |
|---|---|---|---|---|
| 申购金额（美元,a） | 5,000.00 | 500,000.00 | 1,000,000.00 | 2,000,000.00 |
| T日美元折算净值（e） | 0.1951 | 0.1951 | 0.1951 | 0.1951 |
| 申购份额（f=a/e） | 25,627.88 | 2,562,788.31 | 5,125,576,63 | 10,251,153.25 |

例三：假定T日基金的C类基金份额净值为1.2000元，人民币申购金额为10万元，则申购获得的C类基金份额计算如下：

申购份额＝100,000.00/1.2000=83,333.33份

（4）赎回金额的计算

①人民币赎回金额的计算方法如下：

赎回金额＝赎回份额×T日该类基金份额净值

赎回费用＝赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额–赎回费用

②美元赎回金额的计算方法如下：

赎回金额＝赎回份额×T日该类基金份额美元折算净值

赎回费用＝赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额–赎回费用

例四：假定某投资者在T日赎回10,000.00份以人民币申购的A类基金份额，持有期限10天，该日A类基金份额净值为1.2500元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.2500=12,500.00元

赎回费用=12,500.00×0.5%=62.50元

净赎回金额=12,500.00–62.50=12,437.50元

例五：假定某投资者在T日赎回10,000.00份以美元申购的A类基金份额，持有期限20天，该日A类基金份额美元折算净值为0.1983美元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×0.1983=1983.00美元

赎回费用=1983.00×0.5%=9.92美元

净赎回金额=1983.00–9.92=1973.08美元

例六：假定某投资者在T日赎回C类基金份额10,000.00份，持有期限30天，该日C类基金份额净值为1.2500元，则其获得的赎回金额计算如下：

净赎回金额=10,000.00×1.2500=12,500.00元

## 十二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：刘连舸
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：010–66594942
中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2019年6月30日，中国银行已托管716只证券投资基金，其中境内基金676只，QDII基金40只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 十三、境外资产托管人

（一）境外资产托管人基本情况

名称：中国银行（香港）有限公司（简称“中银香港”）
注册地址：香港中环花园道1号中银大厦
办公地址：香港中环花园道1号中银大厦
法定代表人：岳毅
成立时间：1964年10月16日
组织形式：股份有限公司
存续期间：持续经营

中银香港于1964年成立，并在2001年10月1日正式重组为中国银行（香港）有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股母公司中银香港（控股）有限公司（简称“中银香港（控股）”）2001年2日在香港注册成立，2002年7月25日开始在香港联合交易所主板上市，2002年12月2日被纳入为恒生指数成份股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至